万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31日

基金管理人:万家基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
送出日期:2016年3月25日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料已经审计,安永华明会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告,请投资者注意阅读。

本报告期自2015年1月1日起至12月31日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	万家双引擎灵活配置混合
基金主代码	519183
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年6月27日
基金管理人	万家基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	756,177,165.99份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过股票、债券的有效配置,把握价值、成长风格特征,精选个股,构造风格类资产组合。在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金根据对宏观经济环境、经济增长前景及证券市场发展状况的综合分析,结合对股票市场整体估值水平、上市公司利润增长情况,债券市场整体收益率曲线变化等综合指标的分析,形成对各大类资产收益风险水平的前瞻性预测,以此确定股票、固定收益证券和现金等大类资产及中国证监会允许基金投资的其他金融工具在给定区间内的动态配置。
业绩比较基准	60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率
风险收益特征	本基金是混合型基金,风险高于货币市场基金和债券型基金,属于中高风险、中高预期收益的证券投资基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		万家基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	兰剑	张志永
	联系电话	021-38909626	021-62677777*212004
	电子邮箱	lanj@wjasset.com	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		95538转6、4008880800	95561
传真		021-38909627	021-62159217

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.wjasset.com
基金年度报告备置地点	中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8楼(名义楼层9层)基金管理人办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	90,102,980.73	6,835,856.37	9,773,874.58
本期利润	93,360,939.05	9,498,526.34	7,777,085.50
加权平均基金份额本期利润	0.0459	0.1790	0.1205
本期加权平均净值利润率	3.55%	17.74%	12.54%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.3220	0.2042	-0.0108
期末基金资产净值	999,645,087.51	52,303,424.21	62,501,778.83
期末基金份额净值	1.3220	1.2042	0.9892

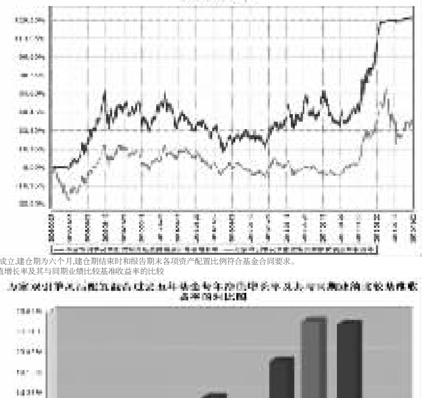
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

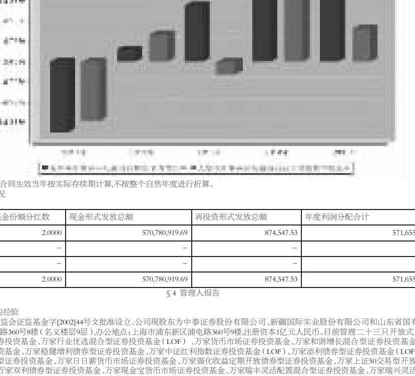
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.58%	0.09%	10.65%	1.01%	-9.07%	-0.92%
过去六个月	1.90%	0.11%	-8.15%	1.61%	10.05%	-1.50%
过去一年	30.53%	0.61%	7.74%	1.49%	22.79%	-0.88%
过去三年	80.13%	1.14%	37.00%	1.07%	43.13%	0.07%
过去五年	54.39%	1.09%	25.18%	0.96%	29.21%	0.13%
自基金合同生效起至今	133.06%	1.13%	39.23%	1.08%	93.83%	0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金于2008年6月27日成立,建仓期为六个月,建仓期结束时和报告期末各项资产配置比例符合基金合同要求。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金于2008年6月27日成立,合同生效当年按实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2015	2.0000	570,780,919.69	874,547.53	571,655,467.22	
2014	-	-	-	-	
2013	-	-	-	-	
合计	2.0000	570,780,919.69	874,547.53	571,655,467.22	

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

万家基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2002]44号文批准设立。公司现股东为中泰证券股份有限公司、新疆国际实业股份有限公司和山东省国有资产投资控股有限公司,住所:中国(上海)自由贸易试验区浦电路360号8楼(名义楼层9层),办公地点:上海市浦东新区浦电路360号9楼,注册资本1亿元人民币。目前管理二十三只开放式基金,分别为万家180指数证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、万家行业优选混合型证券投资基金(LOF)、万家货币市场证券投资基金、万家和谐增长混合型证券投资基金、万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金、万家精选混合型证券投资基金、万家稳健增利债券型证券投资基金、万家中证红利指数证券投资基金(LOF)、万家添利债券型证券投资基金(LOF)、万家中证创业成长指数分级证券投资基金、万家信用恒利债券型证券投资基金、万家日日薪货币市场证券投资基金、万家强化收益定期开放债券型证券投资基金、万家上证50交易型开放式指数证券投资基金、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家现金宝货币市场证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金、万家品质生活灵活配置混合型证券投资基金、万家瑞益灵活配置混合型证券投资基金和万家新兴蓝筹灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高翰昆	本基金基金经理、万家新利灵活配置混合型证券投资基金、万家双利债券型证券投资基金、万家瑞丰灵活配置混合型证券投资基金和万家瑞兴灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2015年5月5日	-	5年	英国诺丁汉大学硕士。2009年7月加入万家基金管理有限公司,历任研究部助理、交易员、交易部总监助理、交易部副总监。
华光磊	本基金基金经理、万家和谐增长混合型证券投资基金基金经理、权益投资部副总监	2013年8月8日	2015年5月22日	11年	学士学位,2004年8月进入光大证券研究所工作,于2008年获得新财富房地产行业最佳分析师第三名(团队);2008年12月加入光大证券资产管理总部,2009年9月加入天弘基金,分别担任研究员、基金经理助理等职务;2011年5月加入万家基金,先后担任研究总监助理、研究总监等职务。
朱颖	本基金基金经理、万家和谐增长混合型基金基金经理	2012年2月4日	2015年2月12日	8年	硕士学位,2006年10月加入万家基金管理有限公司,曾担任行业分析师,基金经理助理。

注:1、此处的任职日期和离任日期均以公告为准。
2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守基金合同、《证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等法律、法规和监管部门的相关规定,依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产,在认真控制投资风险的基础上,为基金持有人谋取最大利益,没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,公司制定了《万家基金管理有限公司公平交易管理办法》,涵盖了研究、授权、投资决策和交易执行等投资管理活动的各个环节,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送,确保公平对待不同投资组合。

在投资决策上:(1)公司对不同类别的投资组合分别设定独立的投资部门,公募基金经理和特定客户资产管理投资经理不得互相兼任。(2)公司投资管理实行分层次决策,投资决策委员会下设的公募基金投资决策小组和专户投资决策小组分别根据公募基金和专户投资组合的规模、风格特征等因素合理确定各投资组合经理的投资权限,投资组合经理在授权范围内自主决策,超过投资权限的操作需经过严格的逐级审批程序。(3)公司接受的外部研究报告、研究员撰写的研究报告等均通过统一的投研管理平台发布,确保各投资组合经理在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

在交易执行上:(1)公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离,实行集中交易制度;(2)对于交易所公开竞价交易,所有指令必须通过系统下达,公司执行交易系统中的公平交易程序;(3)对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易,各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量,公司按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;(4)对于银行间交易,交易部按照时间优先、价格优先的原则公平公正的进行询价并完成交易。

在行为监控上,公司定期对不同投资组合的同向交易价差、反向交易、场外交易对手议价的价格公允性及其他异常交易情况进行监控及分析,基金经理对异常交易情况进行合理性解释并留存记录,并定期编制公平交易分析报告,由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公司定期进行同向交易价差分析,即采集公司旗下管理的所有组合,连续四个季度期间内,不同时间窗下(日内、3日内、5日内)的同向交易样本,对两两组合之间的同向交易价差均值进行原假设为0,95%的置信水平下的检验,并对结论进行跟踪分析,分析结果显示在样本数量大于30的前提下,组合之间在同向交易方面未发现违反公平交易的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内无下列情况:所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年全年,各项宏观数据依然疲弱,ppi继续下跌cpi低位徘徊通缩压力逐步加大,央行全年不断降准降息实施宽松的货币政策。811汇改后,外汇市场出现明显波动并直接影响到国内的股票及债券市场,面对持续的资本流出压力及不稳定的金融市场,12月央行并没有再次降准降息,表明央行的宽松货币政策是比较审慎的。资本市场方面,全年动荡加剧。债券市场由于对基本面的担忧叠加宽松的货币政策,总体呈现一个较强的牛市格局,收益率曲线平坦化发展。权益市场在上半年杠杆牛资金牛改革牛预期下走出一波牛市,但年中叠加去杠杆及基本面背离等情况出现快速杀跌,全年波动巨大。

本基金在兼顾流动性的同时,根据大类资产配置灵活调整各类资产比例,抓住了纯债和权益的投资机会,并积极参与新股申购,获得了较好的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末,该基金份额净值为1.3220元,报告期基金份额净值增长率为30.53%,同期业绩比较基准增长率为7.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望来年,决策层提出了供给侧改革的新思路,短期可能会造成全社会的阶段性阵痛。加之外汇占款流出,基本面筑底,通缩压力加大等因素,央行必然会继续实施宽松的货币政策,很可能会继续降准降息为经济保驾护航,但这会是一个反复的过程。资金可能会继续大量淤积在资本市场,全年资本市场可能会出现一个比较效应,资金在各类资产之间不断切换寻找相对估值便宜的资产。

基于以上判断,本基金会更灵活的操作在债券类资产和权益类资产间做切换,仓位控制会更趋灵活,并在新股政策不变的前提下积极参与打新,努力为持有人获得良好回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1、参与估值流程各方及人员(或小组)的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历

公司成立了估值委员会,定期评价现行估值政策和程序,在发生了影响估值政策和程序有效性及适用性的情况后及时修订估值方法。估值委员会由督察长、基金运营部负责人、合规稽核部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人等组成。估值委员会的成员均具备专业胜任能力和相关从业资格,精通各自领域的理论知识,熟悉政策法规,并具有丰富的实践经验。

2、基金经理参与或决定估值的程度

基金经理可参与估值原则和方法的讨论,但不介入基金日常估值业务。

3、参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4、已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

收益分配基准日为:2015年2月10日;基准日基金份额净值(单位:元):1.2344;分红方案:2.0元/10份基金份额;权益登记日及除息日:2015年2月26日;现金红利发放日:2015年3月2日。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内自1月6日至2月12日,基金资产净值连续28个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情况。

本报告期内自3月5日至4月27日,基金资产净值连续37个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情况。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本基金2015年年度财务会计报告已经安永华明会计师事务所审计,注册会计师签字出具了安永华明(2016)审字第60778298_B07号标准无保留意见的审计报告。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金
报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资产	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资产:		
银行存款	321,283,003.54	11,837,329.42
结算备付金	83,634.71	496,692.97
存出保证金	378,953.30	124,758.53
交易性金融资产	332,663,946.60	41,695,315.60
其中:股票投资	26,405,066.60	41,695,315.60
基金投资	-	-
债券投资	306,258,880.00	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	339,398,029.10	-
应收证券清算款	384,108.35	-
应收利息	7,668,053.60	6,364.93
应收股利	-	-
应收申购款	67,160.32	19,960.48
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	1,001,926,889.52	54,180,421.93
负债和所有者权益	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	966,407.45	1,118,140.79
应付管理人报酬	679,514.77	62,465.47
应付托管费	212,348.36	10,410.91
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	62,302.21	321,599.26
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	361,229.22	364,381.29
负债合计	2,281,802.01	1,876,997.72
所有者权益:		
实收基金	756,177,165.99	43,433,809.20
未分配利润	243,467,921.52	8,869,615.01
所有者权益合计	999,645,087.51	52,303,424.21
负债和所有者权益总计	1,001,926,889.52	54,180,421.93

7.2 利润表

会计主体:万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入	132,113,952.12	12,794,608.16
1.利息收入	66,655,652.64	268,787.02
其中:存款利息收入	32,748,798.00	268,787.02
债券利息收入	19,161,505.68	-
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	14,745,348.96	-
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	38,810,797.51	9,793,092.38
其中:股票投资收益	34,477,788.36	9,648,105.45
基金投资收益	-	-
债券投资收益	2,401,781.75	-
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	1,931,227.40	144,986.93
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	3,257,958.32	2,662,669.97
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	23,389,543.65	70,058.79
减:二、费用	38,753,013.07	3,296,081.82
1. 管理人报酬	28,296,157.47	805,041.29
2. 托管费	6,488,031.76	134,173.54
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	1,890,695.68	1,992,601.49
5. 利息支出	1,623,277.62	-
其中:卖出回购金融资产支出	1,623,277.62	-
6. 其他费用	454,850.54	364,265.50
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	93,360,939.05	9,498,526.34
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	93,360,939.05	9,498,526.34

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	43,433,809.20	8,869,615.01	52,303,424.21
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	93,360,939.05	93,360,939.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以"-"号填列)	712,743,356.79	712,892,834.68	1,425,636,191.47
其中:1.基金申购款	9,025,673,953.68	2,523,248,403.09	11,548,922,356.77
2.基金赎回款	-8,312,930,596.89	-1,810,355,568.41	-10,123,286,165.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-571,655,467.22	-571,655,467.22
五、期末所有者权益(基金净值)	756,177,165.99	243,467,921.52	999,645,087.51
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	63,184,756.97	-682,978.14	62,501,778.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	9,498,526.34	9,498,526.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以"-"号填列)	-19,750,947.77	54,066.81	-19,696,880.96
其中:1.基金申购款	45,101,738.60	5,061,988.91	50,163,727.51
2.基金赎回款	-64,852,686.37	-5,007,922.10	-69,860,608.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	43,433,809.20	8,869,615.01	52,303,424.21

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.3 财务报表由下列负责人签署:

______方一天______	______方一天______	____陈广益____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金"),系经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2008]316号文《关于核准万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》的核准,由基金管理人万家基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于2008年6月27日正式生效,首次设立募集规模为353,835,521.84份基金份额。本基金为契约型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为万家基金管理有限公司,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

2015年5月25日本基金份额持有人大会以通讯方式召开,大会审议并通过《关于修改万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,内容包括本基金修改基金投资范围、投资比例、收益分配方式、及基金合同其他内容修订等事项。自持有人大会决议生效之日起,旧版《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》失效且新版《万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同》同时生效。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行、上市的股票、债券(含中小企业私募债、证券公司短期公司债券)、现金、债券回购、银行存款、资产支持证券、权证及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金通过股票、债券的有效配置,把握价值、成长风格特征,精选个股,构造风格类资产组合。在有效控制风险的前提下,谋求基金资产的持续稳健增值。本基金的业绩比较基准为:60%×沪深300指数收益率+40%×上证国债指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定,自2015年3月30日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值。

除上述会计估计变更外,本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年4月24日起,调整证券(股票)交易印花税税率,由原先的3‰调整为1‰;

经国务院批准,财政部、国家税务总局研究决定,自2008年9月19日起,调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税,受让方不再征收,税率不变;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让,暂免征收印花税。

2、营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定,自2004年1月1日起,对证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入,继续免征营业税和企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税;

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定,对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

3、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,对基金取得的股票的股息、红利收入,债券的利息收入、储蓄存款利息收入,由上市公司、发行债券的企业和银行在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定,股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入,暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税;

根据财政部、国家税务总局财税字[2008]132号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定,自2008年10月9日起,对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2013年1月1日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂减按25%计入应纳税所得额。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定,自2015年9月8日起,证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票,持股期限超过1年的,股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
万家基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	基金托管人、基金代销机构
中泰证券股份有限公司("中泰证券",原"齐鲁证券有限公司")	基金管理人的股东、基金代销机构
新疆国际实业股份有限公司	基金管理人的股东
山东省国有资产投资控股有限公司	基金管理人的股东
万家共赢资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海承方股权投资管理有限公司(原"上海承方投资管理有限公司")	基金管理人控制的公司
天津万家财富资产管理有限公司	基金管理人的子公司
深圳前海万家股权投资管理有限公司	基金管理人控制的公司
上海万家朴智投资管理有限公司	基金管理人控制的公司

注1:报告期内,天津万家财富资产管理有限公司于2015年9月11日由万家基金管理有限公司和自然人李修辞共同出资组建,为基金管理人的子公司。
注2:报告期内,深圳前海万家股权投资管理有限公司于2015年11月27日由天津万家财富资产管理有限公司全资设立,受基金管理人间接控制。
注3:报告期内,上海万家朴智投资管理有限公司于2015年11月20日由天津万家财富资产管理有限公司与上海灏济投资管理中心(有限合伙)共同出资组建,受基金管理人间接控制。

7.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称与本基金的关系
万家基金管理有限公司基金管理人、基金销售机构
兴业银行基金托管人、基金代销机构
中泰证券基金管理人的股东、基金代销机构
注:以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.1 关联方报酬

7.4.8.1.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	28,296,157.47	805,041.29
其中:支付销售机构的客户维护费	863,040.58	174,167.10

注: 2015年1月1日至2015年6月18日

基金管理费按前一日的基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

2015年6月19日起

基金管理费按前一日的基金资产净值的0.80%的年费率计提。计算方法如下:

H=E×1.50%/当年天数
H为每日应支付的基金管理费
E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.1.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	6,488,031.76	134,173.54

注:基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数
H为每日应计提的基金托管费
E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令,经基金托管人复核后于次月首日起2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇不可抗力致使无法按时支付的,顺延至最近可支付日支付。

7.4.8.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.3 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
基金合同生效日(2008年6月27日)持有的基金份额	10021602.16	0.00
期初持有的基金份额	-	10021602.16
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	10021602.16	-
期末持有的基金份额	0	10021602.16
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.00%	23.07%

注:期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额;期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

7.4.8.3.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.8.4 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行	21,283,003.54	4,935,568.98	11,837,329.42	258,104.68

注:本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限公司,2015年度获得的利息收入人民币26,148.72元(2014年度:人民币7962.22元),2015年末结算备付金余额为83,634.71元(2014年末:人民币496,692.97元)。

7.4.8.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别:股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002778	高科石化	2015年12月28日	2016年1月6日	认购新发股票	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00	-

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002103	广博股份	2015年9月7日	筹划重大资产重组	31.13	2016年2月16日	19.27	600,000	15,405,729.22	18,678,000.00	-

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止,本基金无银行间市场债券正回购余额。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止,本基金无交易所市场债券正回购余额。

7.4.9.4 风险管理政策和组织架构

本基金管理人将风险管理融入各业务层面,建立了三道防线:以各岗位目标责任制为基础,形成第一道防线;通过相关部门、相关岗位之间相互监督制衡,形成第二道防线;由监察稽核部门、督察长对各岗位、各部门、各机构、各项业务实施监督反馈,形成第三道防线。

7.4.9.5 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上 市公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外,在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

7.4.9.5.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

短期信用评级	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	301,251,000.00	-
合计	301,251,000.00	-

7.4.9.5.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

长期信用评级	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
AAA	670,680.00	-
AAA以下	-	-
未评级	4,337,200.00	-
合计	5,007,880.00	-

7.4.9.6 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额,另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持证券大部分在银行间同业市场交易,均其余亦可在证券交易所上市,因此除在附注7.4.12中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外,本期末本基金的其余资产均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过风险管理人员设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.9.7 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和市场价格风险。

7.4.9.7.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资、买入返售金融资产及部分应收申购款等。

7.4.9.7.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2015年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	321,283,003.54	-	-	-	-	-	321,283,003.54
结算备付金	83,634.71	-	-	-	-	-	83,634.71
存出保证金	378,953.30	-	-	-	-	-	378,953.30
交易性金融资产	40,260,000.00	50,256,000.00	210,735,000.00	670,680.00	4,337,200.00	26,405,066.60	332,663,946.60
买入返售金融资产	339,398,029.10	-	-	-	-	-	339,398,029.10
应收证券清算款	-	-	-	-	-	384,108.35	384,108.35
应收利息	-	-	-	-	-	7,668,053.60	7,668,053.60
应收申购款	-	-	-	-	-	67,160.32	67,160.32
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	701,403,620.65	50,256,000.00	210,735,000.00	670,680.00	4,337,200.00	34,524,388.87	1,001,926,889.52
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	966,407.45	966,407.45
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	679,514.77	679,514.77
应付托管费	-	-	-	-	-	212,348.36	212,348.36
应付交易费用	-	-	-	-	-	62,302.21	62,302.21
其他负债	-	-	-	-	-	361,229.22	361,229.22
负债总计	-	-	-	-	-	2,281,802.01	2,281,802.01
利率敏感度缺口	701,403,620.65	50,256,000.00	210,735,000.00	670,680.00	4,337,200.00	32,242,586.86	999,645,087.51
上年度末 2014年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	11,837,329.42	-	-	-	-	-	11,837,329.42
结算备付金	496,692.97	-	-	-	-	-	496,692.97
存出保证金	124,758.53	-	-	-	-	-	124,758.53
交易性金融资产	-	-	-	-	-	41,695,315.60	41,695,315.60
应收利息	-	-	-	-	-	6,364.93	6,364.93
应收申购款	497.02	-	-	-	-	19,463.46	19,960.48
资产总计	12,459,277.94	-	-	-	-	41,721,143.99	54,180,421.93
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,118,140.79	1,118,140.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	62,465.47	62,465.47
应付托管费	-	-	-	-	-	10,410.91	10,410.91
应付交易费用	-	-	-	-	-	321,599.26	321,599.26
其他负债	-	-	-	-	-	364,381.29	364,381.29
负债总计	-	-	-	-	-	1,876,997.72	1,876,997.72
利率敏感度缺口	12,459,277.94	-	-	-	-	39,844,146.27	52,303,424.21

注:该表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值,并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.9.7.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	若市场利率发生变动而其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2015年12月31日)	上年度末(2014年12月31日)
	1.市场利率下降25个基点	239,646.33	-
	2.市场利率上升25个基点	-238,205.81	-

注:该表为利率风险的敏感性分析,反映了在其他变量不变的假设下,利率发生合理、可能的变动时,为交易而持有的债券公允价值的变动将对基金净值产生的影响。

7.4.9.7.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价,因此无外汇风险。

7.4.9.7.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券,所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险,并且基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.9.7.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		上年度末 2014年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	26,405,066.60	2.64	41,695,315.60	79.72
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	306,258,880.00	30.64	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	332,663,946.60	33.28	41,695,315.60	79.72

注:本基金投资组合中股票投资比例范围为基金资产净值的30%-80%债券、现金类资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种为20%-70%;其中,现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%权证为基金资产净值的0%-3%资产支持证券为0%-20%。于资产负债表日,本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

7.4.9.7.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	若股票基准指数发生变动而其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2015年12月31日)	上年度末(2014年12月31日)
	1.股票基准指数下降100个基点	-181,102.93	-465,555.78
	2.股票基准指数上升100个基点	181,102.93	465,555.78

注:本基金管理人运用资本-资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析,反映了在其他变量不变的假设下,证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时,将对基金资产净值产生的影响。

7.4.9.7.4 采用风险价值法管理风险

7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1公允价值

7.4.14.1.1不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、应收款项、买入返售金融资产以及其他金融负债,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

7.4.14.1.2 以公允价值计量的金融工具

7.4.14.1.2.1各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币7,679,466.60元,属于第二层次的余额为人民币324,984,480.00元,无属于第三层次的余额。(于2014年12月31日,第一层次的余额为人民币40,446,715.60元,属于第二层次的余额为人民币1,248,600.00元,无属于第三层次余额)。

7.4.14.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况,本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

根据中国证券投资基金业协会中基协发(2014)24号《关于发布<中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准>的通知》的规定,自2015年3月30日起,交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种采用第三方估值机构提供的估值数据进行估值,相关固定收益品种的公允价值所属层级从第一层次转入第二层次。

7.4.14.1.2.3第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具本期末和上期末均不以第三层次公允价值计量。

7.4.14.2承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的重大承诺事项。

7.4.14.3其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	26,405,066.60	2.64
	其中:股票	26,405,066.60	2.64
2	固定收益投资	306,258,880.00	30.57
	其中:债券	306,258,880.00	30.57
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	339,398,029.10	33.87
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	321,366,638.25	32.07
7	其他各项资产	8,498,275.57	0.85
8	合计	1,001,926,889.52	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	23,005,417.43	2.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	569,223.75	0.06
F	批发和零售业	222,304.44	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	976,866.00	0.10
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,451,354.98	0.15
J	金融业	179,900.00	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	26,405,066.60	2.64

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002103	广博股份	600,000	18,678,000.00	1.87
2	000910	大亚科技	79,800	1,319,892.00	0.13
3	600270	外运发展	36,100	976,866.00	0.10
4	300496	中科创达	6,560	918,465.60	0.09
5	000513	丽珠集团	10,400	597,272.00	0.06
6	300495	美尚生态	6,375	569,223.75	0.06
7	002013	中航机电	20,000	453,200.00	0.05
8	300032	金龙机电	14,000	425,600.00	0.04
9	300493	润欣科技	7,248	299,632.32	0.03
10	002782	可立克	13,312	283,146.24	0.03

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本基金管理人网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	44,117,319.96	84.35
2	601318	中国平安	36,012,106.75	68.85
3	002103	广博股份	30,500,776.22	58.32
4	600036	招商银行	25,511,240.00	48.78
5	601288	农业银行	22,118,112.00	42.29
6	600030	中信证券	16,907,334.00	32.33
7	600000	浦发银行	14,912,843.63	28.51
8	600837	海通证券	13,826,363.64	26.43
9	601766	中国中车	13,245,756.94	25.32
10	002241	歌尔声学	13,137,483.68	25.12
11	601328	交通银行	12,760,853.81	24.40
12	002179	中航光电	12,692,256.00	24.27
13	601989	中国重工	12,028,494.72	23.00
14	601988	中国银行	11,695,531.00	22.36
15	601668	中国建筑	10,516,715.00	20.11
16	600887	伊利股份	10,324,840.22	19.74
17	601398	工商银行	10,124,074.00	19.36
18	601818	光大银行	9,335,912.00	17.85
19	601169	北京银行	9,283,679.60	17.75
20	600519	贵州茅台	9,089,493.00	17.38
21	601688	华泰证券	8,591,811.29	16.43
22	601390	中国中铁	7,825,298.40	14.96
23	600089	特变电工	7,654,580.28	14.63
24	601601	中国太保	7,442,791.00	14.23
25	601006	大秦铁路	6,474,469.05	12.38
26	600048	保利地产	6,311,272.00	12.07
27	600028	中国石化	5,874,731.83	11.23
28	600104	上汽集团	5,851,109.41	11.19
29	002170	芭田股份	5,439,984.36	10.40
30	600015	华夏银行	5,368,834.00	10.26
31	600050	中国联通	4,877,751.00	9.33
32	600999	招商证券	4,861,772.00	9.30
33	601628	中国人寿	4,697,790.00	8.98
34	600352	浙江龙盛	4,636,869.78	8.87
35	600111	北方稀土	4,519,733.14	8.64
36	601857	中国石油	4,375,968.92	8.37
37	600637	东方明珠	4,354,822.92	8.33
38	600518	康美药业	4,279,159.42	8.18
39	601186	中国铁建	4,260,734.00	8.15
40	601901	方正证券	3,866,624.76	7.39
41	002653	海思科	3,796,896.00	7.26
42	300380	安硕信息	3,653,724.08	6.99
43	600079	人福医药	3,615,805.00	6.91
44	600690	青岛海尔	3,607,170.00	6.90
45	300226	上海钢联	3,568,164.00	6.82
46	600109	国金证券	3,447,689.00	6.59
47	600893	中航动力	3,431,054.10	6.56
48	600585	海螺水泥	3,365,018.18	6.43
49	601088	中国神华	3,225,242.00	6.17
50	600270	外运发展	3,143,629.59	6.01
51	600583	海油工程	2,888,501.00	5.52
52	601800	中国交建	2,851,073.00	5.45
53	600150	中国船舶	2,755,578.60	5.27
54	300463	迈克生物	2,718,327.12	5.20
55	601998	中信银行	2,702,623.00	5.17
56	600256	广汇能源	2,567,545.40	4.91
57	600406	国电南瑞	2,352,476.41	4.50
58	603116	红蜻蜓	2,312,823.60	4.42
59	603979	金诚信	2,271,245.94	4.34
60	600271	航天信息	2,253,054.76	4.31
61	002013	中航机电	2,217,467.00	4.24
62	002142	宁波银行	2,111,495.00	4.04
63	600581	八一钢铁	2,066,163.00	3.95
64	000671	阳 光 城	2,033,918.00	3.89
65	600211	西藏药业	1,868,303.12	3.57
66	300032	金龙机电	1,745,067.00	3.34
67	000651	格力电器	1,668,000.00	3.19
68	300026	红日药业	1,651,757.89	3.16
69	600031	三一重工	1,613,113.26	3.08
70	600018	上港集团	1,605,365.00	3.07
71	601377	兴业证券	1,592,750.00	3.05
72	000513	丽珠集团	1,590,946.20	3.04
73	000150	宜华健康	1,557,736.00	2.98
74	603989	艾华集团	1,524,929.24	2.92
75	000728	国元证券	1,498,820.00	2.87
76	002174	游族网络	1,475,400.00	2.82
77	600019	宝钢股份	1,468,028.10	2.81
78	300115	长盈精密	1,450,600.00	2.77
79	603589	口子窖	1,445,376.00	2.76
80	002756	永兴特钢	1,440,622.84	2.75
81	603198	迎驾贡酒	1,423,316.00	2.72
82	000910	大亚科技	1,360,160.00	2.60
83	300485	赛升药业	1,336,254.24	2.55
84	000425	徐工机械	1,329,115.14	2.54
85	002268	卫 士 通	1,275,980.72	2.44
86	300036	超图软件	1,268,357.72	2.42
87	601299	中国北车	1,254,211.00	2.40
88	600372	中航电子	1,225,026.15	2.34
89	002236	大华股份	1,191,958.17	2.28
90	000952	广济药业	1,189,195.88	2.27
91	002557	洽洽食品	1,175,510.20	2.25
92	002657	中科金财	1,174,260.00	2.25
93	600391	成发科技	1,168,094.00	2.23
94	600388	龙净环保	1,162,056.50	2.22
95	600872	中炬高新	1,139,000.00	2.18
96	600172	黄河旋风	1,136,396.00	2.17
97	300104	乐视网	1,134,480.00	2.17
98	000732	泰禾集团	1,113,645.00	2.13

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	46,744,896.64	89.37
2	601318	中国平安	35,408,143.21	67.70
3	600036	招商银行	24,302,971.83	46.47
4	601288	农业银行	21,541,028.00	41.18
5	600030	中信证券	16,139,747.48	30.86
6	002179	中航光电	14,279,400.19	27.30
7	600000	浦发银行	13,631,006.00	26.06
8	601988	中国银行	13,017,578.00	24.89
9	002103	广博股份	12,790,313.00	24.45
10	600837	海通证券	12,374,592.05	23.66
11	002241	歌尔声学	12,255,396.38	23.43
12	601989	中国重工	12,056,142.37	23.05
13	601766	中国中车	10,881,177.92	20.80
14	601328	交通银行	10,490,591.12	20.06
15	600048	保利地产	9,894,515.52	18.92
16	600887	伊利股份	9,844,511.35	18.82
17	601668	中国建筑	9,777,546.98	18.69
18	601398	工商银行	8,990,674.73	17.19
19	601818	光大银行	8,733,760.00	16.70
20	600519	贵州茅台	8,348,440.20	15.96
21	601169	北京银行	8,317,221.39	15.90
22	601390	中国中铁	8,105,736.55	15.50
23	601688	华泰证券	7,592,582.29	14.52
24	600089	特变电工	6,945,302.17	13.28
25	601601	中国太保	6,635,354.33	12.69
26	600352	浙江龙盛	6,087,031.72	11.64
27	002170	芭田股份	6,071,537.78	11.61
28	601006	大秦铁路	5,924,689.39	11.33
29	601628	中国人寿	5,870,225.04	11.22
30	600104	上汽集团	5,690,073.00	10.88
31	600028	中国石化	5,666,034.00	10.83
32	600050	中国联通	5,037,224.00	9.63
33	600999	招商证券	5,015,398.00	9.59
34	600015	华夏银行	4,692,964.07	8.97
35	601186	中国铁建	4,552,234.60	8.70
36	601857	中国石油	4,421,458.00	8.45
37	600111	北方稀土	4,289,085.00	8.20
38	300380	安硕信息	4,279,869.49	8.18
39	300226	上海钢联	4,205,251.00	8.04
40	300463	迈克生物	4,129,902.07	7.90
41	600637	东方明珠	4,061,871.51	7.77
42	002653	海思科	4,036,823.51	7.72
43	600518	康美药业	3,946,956.89	7.55
44	600079	人福医药	3,922,130.78	7.50
45	000024	招商地产	3,572,071.23	6.83
46	603989	艾华集团	3,441,602.40	6.58
47	600690	青岛海尔	3,438,309.56	6.57
48	600893	中航动力	3,415,912.99	6.53
49	002756	永兴特钢	3,274,544.00	6.26
50	600271	航天信息	3,207,054.30	6.13
51	600585	海螺水泥	3,103,192.01	5.93
52	601088	中国神华	3,097,489.55	5.92
53	601800	中国交建	3,015,418.00	5.77
54	601901	方正证券	2,999,183.00	5.73
55	603198	迎驾贡酒	2,954,316.10	5.65
56	601998	中信银行	2,896,811.55	5.54
57	600150	中国船舶	2,609,373.00	4.99
58	603116	红蜻蜓	2,503,558.00	4.79
59	600109	国金证券	2,490,370.00	4.76
60	600340	华夏幸福	2,488,800.00	4.76
61	603885	吉祥航空	2,441,422.34	4.67
62	600270	外运发展	2,415,460.20	4.62
63	000528	柳 工	2,335,173.12	4.46
64	600583	海油工程	2,301,321.66	4.40
65	603979	金诚信	2,289,614.10	4.38
66	002174	游族网络	2,269,723.62	4.34
67	000150	宜华健康	2,267,967.98	4.34
68	601336	新华保险	2,228,252.00	4.26
69	600256	广汇能源	2,170,301.00	4.15
70	600406	国电南瑞	2,147,820.00	4.11
71	000671	阳 光 城	2,127,435.00	4.07
72	300115	长盈精密	2,080,605.61	3.98
73	600211	西藏药业	1,949,322.00	3.73
74	000786	北新建材	1,946,890.30	3.72
75	600018	上港集团	1,943,832.00	3.72
76	600500	中化国际	1,938,090.00	3.71
77	600581	八一钢铁	1,928,691.00	3.69
78	601299	中国北车	1,918,800.00	3.67
79	000333	美的集团	1,916,364.00	3.66
80	603566	普莱柯	1,839,624.80	3.52
81	601377	兴业证券	1,833,650.00	3.51
82	002236	大华股份	1,813,344.61	3.47
83	603589	口子窖	1,811,956.44	3.46
84	002013	中航机电	1,784,807.00	3.41
85	002142	宁波银行	1,782,259.88	3.41
86	300026	红日药业	1,742,978.53	3.33
87	000651	格力电器	1,694,969.00	3.24
88	600031	三一重工	1,688,696.00	3.23
89	600118	中国卫星	1,685,900.00	3.22
90	603108	润达医疗	1,663,987.00	3.18
91	000728	国元证券	1,648,650.00	3.15
92	002657	中科金财	1,632,465.00	3.12
93	601233	桐昆股份	1,619,513.00	3.10
94	002157	正邦科技	1,599,141.00	3.06
95	601669	中国电建	1,596,986.97	3.05
96	300253	卫宁软件	1,567,423.64	3.00
97	300485	赛升药业	1,563,295.40	2.99
98	603128	华贸物流	1,554,689.98	2.97
99	600019	宝钢股份	1,552,998.00	2.97
100	000680	山推股份	1,541,089.00	2.95
101	603669	灵康药业	1,488,227.61	2.85
102	300468	四方精创	1,445,961.89	2.76
103	603300	华铁科技	1,428,775.26	2.73
104	300130	新国都	1,413,073.00	2.70
105	002268	卫 士 通	1,399,255.00	2.68
106	603968	醋化股份	1,382,239.44	2.64
107	000425	徐工机械	1,375,542.00	2.63
108	603568	伟明环保	1,370,662.50	2.62
109	600872	中炬高新	1,323,561.00	2.53
110	600172	黄河旋风	1,313,558.00	2.51
111	603311	金海环境	1,290,610.06	2.47
112	000513	丽珠集团	1,256,399.14	2.40
113	300465	高伟达	1,248,660.00	2.39
114	300032	金龙机电	1,230,494.00	2.35
115	603901	永创智能	1,228,044.94	2.35
116	002770	科迪乳业	1,223,724.70	2.34
117	000810	创维数字	1,206,342.60	2.31
118	002557	洽洽食品	1,199,756.00	2.29
119	300104	乐视网	1,191,459.00	2.28
120	300451	创业软件	1,185,789.85	2.27
121	000952	广济药业	1,153,233.00	2.20
122	300036	超图软件	1,144,679.92	2.19
123	600388	龙净环保	1,119,653.50	2.14
124	002773	康弘药业	1,119,550.18	2.14
125	000732	泰禾集团	1,096,899.31	2.10
126	603117	万林股份	1,094,065.40	2.09
127	002753	永东股份	1,053,350.00	2.01

注:卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	588,938,976.07
卖出股票收入(成交)总额	640,879,657.72

注:买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票,"买入金额"按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票,"卖出金额"按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	4,337,200.00	0.43
2	央行票据	-	-
3	金融债券	220,747,000.00	22.08
	其中:政策性金融债	220,747,000.00	22.08
4	企业债券	670,680.00	0.07
5	企业短期融资券	80,504,000.00	8.05
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	306,258,880.00	30.64

注:本基金本报告未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	150206	15国开06	900,000	90,387,000.00	9.04
2	150211	15国开11	900,000	90,261,000.00	9.03
3	011598008	15浙物产SCP008	400,000	40,260,000.00	4.03
4	011510004	15中电投SCP004	400,000	40,244,000.00	4.03
5	150411	15农发11	300,000	30,087,000.00	3.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告未持有资产支持证券。

8.8 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不可投资于股指期货。

8.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同,本基金暂不可投资于国债期货。

8.10 投资组合报告附注

8.10.1

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的情况,在报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

8.10.2

基金投资的前十名股票中,不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.10.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	378,953.30
2	应收证券清算款	384,108.35
3	应收股利	-
4	应收利息	7,668,053.60
5	应收申购款	67,160.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,498,275.57

8.10.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.10.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002103	广博股份	18,678,000.00	1.87	重大资产重组

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
6,381	118,504.49	721,145,654.30	95.37%	35,031,511.69	4.63%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,800.63	0.00%

注:截至本报告期末,本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为0,本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2008年6月27日)基金份额总额	353,835,521.84
本报告期期初基金份额总额	43,433,809.20
本报告期基金总申购份额	9,025,673,953.68
减:本报告期基金总赎回份额	8,312,930,596.89
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
本报告期期末基金份额总额	756,177,165.99

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

2015年5月25日召开基金份额持有人大会,会议通过《关于修改万家双引擎灵活配置混合型证券投资基金基金合同有关事项的议案》,按照相关法律法规及中国证监会的有关规定对本基金的投资范围、投资策略、收益分配方式等事项进行相应修改。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1董事长变更:2015年7月25日,本公司发布公告,聘任方一天为万家基金管理有限公司董事长,毕玉国先生因工作原因不再担任本公司董事长职务。
总经理变更:2015年2月17日,本公司发布公告,聘任方一天为万家基金管理有限公司总经理。
督察长变更:2015年4月11日,本公司发布公告,聘任兰剑为万家基金管理有限公司督察长。
副总经理变更:2015年2月3日,本公司发布公告,聘任李修辞为万家基金管理有限公司副总经理。2015年3月11日,本公司发布公告,蔡志令因个人原因离职,不再担任公司副总经理。2015年10月9日,本公司发布公告,李修辞因个人原因离职,不再担任公司副总经理。
万家双引擎:2015年2月12日本公司发布公告,原基金经理朱颖因个人原因离职,不再担任本基金基金经理。
2015年5月5日本公司发布公告,聘任高翰昆为本基金基金经理,与原基金经理华光磊共同管理本基金。
2015年5月23日本公司发布公告,原基金经理华光磊因个人原因离职,不再担任本基金基金经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

2015年5月25日召开基金份额持有人大会,增加资产支持证券、证券公司短期公司债券、中小企业私募债券投资策略。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自2009年4月起聘请安永华明会计师事务所为本基金提供审计服务。
本基金2015年度需向安永华明会计师事务所支付审计费50000元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内,本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
联合证券	1	543,701,432.22	44.88%	495,316.84	44.65%	-
海通证券	1	403,535,881.67	33.31%	370,923.72	33.44%	-
招商证券	2	145,613,565.55	12.02%	132,567.01	11.95%	-
中金	1	91,404,985.54	7.55%	85,125.51	7.67%	-
国泰君安	1	27,188,577.16	2.24%	25,295.24	2.28%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-

注:1、基金专用交易席位的选择标准如下:
(1)经营行为稳健规范,内控制度健全,在业内有良好的声誉;
(2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件,交易设施满足基金进行证券交易的需要;
(3)具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。
2、基金专用交易席位的选择程序如下:
(1)本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易席位的证券经营机构;
(2)基金管理人和被选中的证券经营机构签订席位租用协议。
3、报告期内基金租用证券公司交易单元的变更情况:无。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
联合证券	6,794,569.20	60.91%	1,398,100,000.00	67.74%	-	-
海通证券	4,360,662.13	39.09%	-	-	-	-
招商证券	-	-	665,852,000.00	32.26%	-	-
中金	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2015年3月31日,万家基金管理有限公司发布关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告,经与相关托管银行、会计事务所协商一致,自2015年3月30日起,本公司对旗下证券投资基金持有的在上海证券交易所、深圳证券交易所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)的估值方法进行调整,采用第三方估值机构提供的价格数据处理进行估值。于2015年3月30日,相关调整对前一估值日基金资产净值的影响不超过0.50%。

万家基金管理有限公司
2016年3月25日